

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年1月10日

清算报告公告日：2025年1月17日

华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 11 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]3847 号）注册募集。《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）自 2022 年 4 月 15 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2024 年 12 月 18 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据基金合同约定，本基金管理人决定终止本基金基金合同，并对本基金基金财产进行清算，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2024 年 12 月 19 日刊登了《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2024 年 12 月 18 日，自 2024 年 12 月 19 日起进入清算程序。自 2024 年 12 月 19 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2024 年 12 月 19 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞恒悦混合
基金代码	014577
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年4月15日
最后运作日 (2024年12月18日) 基金份额总额	3,588,029.36份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极灵活的合理资产配置,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置 本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素,对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析,合理预测各类资产的价格变动趋势,确定不同资产类别的投资比例。在此基础上,积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化,动态调整各大类资产之间的投资比例,在保持总体风险水平相对平稳的基础上,获取相对较高的基金投资收益。2、债券组合投资策略;3、股票投资策略;4、存托凭证投资策略;5、资产支持证券投资策略;6、衍生品投资策略;7、信用衍生品投资策略;8、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	上证国债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。本基金可能投资

	港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 11 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]3847 号）注册募集。

《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）自 2022 年 4 月 15 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2024 年 12 月 18 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据基金合同约定，本基金管理人决定终止本基金基金合同，并对本基金基金财产进行清算，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2024 年 12 月 19 日刊登了《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2024 年 12 月 18 日，自 2024 年 12 月 19 日起进入清算程序。自 2024 年 12 月 19 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2024 年 12 月

19 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月18日

单位：人民币元

资产	本期末 2024年12月18日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	1,337,447.20
结算备付金	469,056.66
存出保证金	26,399.39
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	3,564,191.05
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	5,397,094.30

负债和净资产	本期末 2024年12月18日 (基金最后运作日)
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	1,491,119.94
应付管理人报酬	6,143.88
应付托管费	1,023.99
应付销售服务费	1,989.89
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	184,917.37
负债合计	1,685,195.07
净资产：	-
实收基金	3,588,029.36
其他综合收益	-
未分配利润	123,869.87
净资产合计	3,711,899.23
负债和净资产总计	5,397,094.30

注：报告截止日 2024 年 12 月 18 日，基金份额总额 3,588,029.36 份，其中华泰柏瑞恒悦混合 A 类基金份额净值 1.0397 元，基金份额 287,366.45 份；华泰柏瑞恒悦混合 C 类基金份额净值 1.0341 元，基金份额 3,300,662.91 份。

财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师许培菁、张亚旒签字出具了安永华明（2025）专字第 70025451_B01 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2024 年 12 月 19 日至 2025 年 1 月 3 日为止为本基金清算期间，本基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、资产处置情况

1.1 本基金最后运作日银行存款为人民币 1,337,447.2 元，其中托管户存款为人民币 1,333,553.01 元，应计银行存款利息为人民币 3,894.19 元，上述利息已于 2024 年 12 月 23 日划入基金托管账户。清算款划出日前一日的应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

1.2 基金最后运作日结算备付金为人民币 469,056.66 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 355,767.32 元，应计结算备付金利息为人民币 682.42 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 15,257.10 元，应计结算备付金利息为人民币 97.55 元；应计沪港通预付款利息为人民币 363.35 元；存放于华泰期货有限公司的结算备付金为人民币 88,949.38，应计结算备付金利息为人民币 7,939.54 元。上述利息已于 2024 年 12 月 23 日划入基金托管账户，华泰期货有限公司的结算备付金已于 2024 年 12 月 24 日划入基金托管账户。清算款划出日前一日的该部分应计利息与尚未划回基金托管账户的结算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 26,399.39 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 9,933.21 元，应计存出保证金利息为人民币 52.93 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 16,336.69 元，应计存出保证金利息为人民币 70.02 元；应计港股通存出保证金利息为人民币 6.54 元。截至 2025 年 1 月 3 日上述存出保证金及应计利息已全部划入基金托管户。清算款划出日前一日的该部分应计利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

1.4 本基金最后运作日证券清算款为人民币 3,564,191.05 元，截至 2024 年 12 月 19 日已全部划入基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,143.88 元，已于 2024 年 12 月 20 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,023.99 元，已于 2024 年 12 月 20 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,989.89 元，已于 2024 年 12 月 20 日支付。

2.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,491,119.94 元，已于 2024 年 12 月 19 日支付。

2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 184,917.37 元。其中应付招商证券股份有限公司交易费用为人民币 18,854.26 元，该款项已于 2024 年 12 月 24 日支付；应付中央国债登记结算有限责任公司债券结算服务费为人民币 450.00 元，该款项已于 2024 年 12 月 20 日支付；应付债券交易手续费为人民币 75.00 元，该款项已于 2024 年 12 月 20 日支付；预提上清所账户维护费为人民币 4,800.00 元，已于 2024 年 12 月 23 日支付；预提审计费为人民币 40,000.00 元，已于 2025 年 1 月 2 日支付；预提信息披露费为人民币 115,738.11 元，已于 2024 年 12 月 24 日全额冲回；预提中债登账户维护费为人民币 4,500.00 元，已于 2024 年 12 月 20 日支付；预提划款手续费为人民币 500.00 元，截至 2025 年 1 月 3 日尚未支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，清算过程中发生的费用主要为划款手续费。

4、停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项 目	最后运作日后一日至清算结束日： 2024年12月19日至2025年1月3日
一、营业总收入	1,188.11
1.利息收入	1,188.11
其中：存款利息收入	-
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-105,707.11
1. 管理人报酬	-
其中：暂估管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	-105,707.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	106,895.22
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	106,895.22
五、其他综合收益的税后净额	-

六、综合收益总额	106,895.22
----------	------------

注：1、利息收入系自2024年12月19日至2025年1月3日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入及结算备付金利息收入。

2、其他费用系2024年12月24日冲回的预提信息披露费115,738.11元，2024年12月25日计提并支付的律师费10,000.00元，2025年1月2日计提并支付的汇款手续费31.00元。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年12月18日基金净资产	3,711,899.23
加：清算期间净收益	106,895.22
减：确认赎回对净值的影响	495,177.93
二、2025年1月3日基金资产净值	3,323,616.52

截至本次清算期结束日2025年1月3日，本基金剩余财产为3,323,616.52元。本基金剩余财产将在扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本基金最后运作日后一日2024年12月19日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具法律意见书一并报上海证监局备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行基金剩余财产的分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 《华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 www.huatai-pb.com。

3、查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2025年1月10日